

Fecha de Publicación: 29 de abril de 2015

Fecha de Información: 27 de abril de 2015 ¹

INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$1712.3 millones con una devaluación implícita promedio ponderada por monto de 3.5%.²

Cuadro No. 1
Contratos Forwards Pactados

| Rango | Sector Financiero** | | Intragrupa y Off-shore*** | | Otros Agentes | | Interbancarios |
|--------------|---------------------|--------------|---------------------------|--------------|---------------|--------------|----------------|
| | Compras | Ventas | Compras | Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 450.3 | 116.3 | 71.5 | 409.0 | 13.8 | 10.3 | 31.0 |
| 15-35 | 412.4 | 537.6 | 378.8 | 246.0 | 49.3 | 56.9 | 109.5 |
| 36-60 | 129.8 | 66.4 | 0.0 | 0.0 | 41.4 | 104.8 | 25.0 |
| 61-90 | 0.7 | 12.3 | 0.0 | 0.0 | 12.3 | 0.7 | 0.0 |
| 91-180 | 85.9 | 48.1 | 10.0 | 20.0 | 36.5 | 64.3 | 1.6 |
| >180 | 2.7 | 18.5 | 0.0 | 0.0 | 16.7 | 1.0 | 1.7 |
| Total | 1081.8 | 799.3 | 460.4 | 675.0 | 170.1 | 238.0 | 168.8 |

* Cifras en millones de dólares

**Incluye operaciones interbancarias y operaciones con los otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

Cuadro No. 2

Devaluación Implícita Ponderada por monto Anualizada

| Rango | Sector Financiero* | Otros Agentes sin intragrupo | | Total |
|--------------|--------------------|------------------------------|--------------|--------------|
| | Compras/Ventas | Compras | Ventas | |
| 3-14 | 3.6 % | 0.4 % | 3.5 % | 3.1 % |
| 15-35 | 3.5 % | 3.6 % | 3.3 % | 3.5 % |
| 36-60 | 1.8 % | 4.2 % | 3.6 % | 3.5 % |
| 61-90 | - | 4.3 % | 4.1 % | 4.3 % |
| 91-180 | 3.9 % | 4.3 % | 3.6 % | 3.9 % |
| >180 | 3.7 % | 4.3 % | 3.1 % | 4.2 % |
| Total | 3.2 % | 3.5 % | 3.5 % | 3.5 % |

*Incluye solo operaciones interbancarias

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.

Cuadro No. 3
Vencimientos de Forwards

| Sectores | 27 de abr. al 1 de mayo | | | | 4 al 8 de mayo | | | | 11 al 15 de mayo | | | |
|---------------------------|-------------------------|------------|-------------|-------------|----------------|------------|-------------|-------------|------------------|------------|-------------|-------------|
| | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | | Delivery | | NDF | |
| | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V | C | V |
| Sector Financiero** | 8 | 96 | 2251 | 2639 | 11 | 93 | 2519 | 2409 | 11 | 94 | 2613 | 2960 |
| Intragrupa y off-shore*** | 0 | 0 | 1599 | 1107 | 0 | 0 | 1565 | 1219 | 0 | 0 | 2074 | 892 |
| Otros | 96 | 8 | 527 | 632 | 93 | 11 | 486 | 943 | 94 | 11 | 483 | 1317 |
| Total | 104 | 104 | 4377 | 4377 | 104 | 104 | 4571 | 4571 | 105 | 105 | 5170 | 5170 |

* Cifras en millones de dólares; No incluye operaciones aceptadas por Cámaras de Riesgo Central de Contraparte.

**Incluye operaciones interbancarias y con otros agentes

***Operaciones entre filiales (casas matrices y filiales) y con entidades del exterior.

¹ Datos provisionales.

² El monto negociado diario corresponde a las operaciones de compra y venta evitando la doble contabilización de las operaciones interbancarias. Además, la fórmula para la devaluación implícita es: $((\text{Tasa Pactada/Tasa de Contado}) \wedge (360/\text{Plazo})) - 1$. Para el cálculo de la devaluación implícita se excluyen las operaciones intragrupo.